

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ銀行・単体)					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	47,722,550	47,287,360	4,039,691	4,003,630
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	46,226,584	45,967,090	3,920,014	3,898,009
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	1,495,965	1,320,270	119,677	105,621
4	カウンターパーティ信用リスク	5,138,369	5,788,811	419,344	471,528
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	1,059,768	1,121,855	89,868	95,133
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	3,122,848	3,698,534	249,827	295,882
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	291,473	335,285	23,317	26,822
	その他	664,278	633,136	56,330	53,689
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	17,821	19,266	1,511	1,633
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	2,469,376	2,549,264	209,332	215,376
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	81,455	85,886	6,904	7,277
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	9,938	11,101	842	941
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	34	38	2	3
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	2,247	4,706	179	376
11	未決済取引	2,451	8,579	207	727
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	1,332,690	1,440,785	106,615	115,262
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	431,843	516,344	34,547	41,307
14	うち、外部格付準拠方式適用分	434,909	461,463	34,792	36,917
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	359,218	356,278	28,737	28,502
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	106,719	106,698	8,537	8,535
16	マーケット・リスク	963,327	981,352	77,066	78,508
17	うち、標準的方式適用分	78,366	71,116	6,269	5,689
18	うち、内部モデル方式適用分	884,961	910,235	70,796	72,818
19	オペレーショナル・リスク	3,029,793	3,027,756	242,383	242,220
20	うち、基礎的手法適用分	30,061	27,803	2,404	2,224
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	2,999,731	2,999,952	239,978	239,996
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	581,179	606,849	49,284	51,460
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	20,215,807	16,859,476	1,617,264	1,348,758
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	84,632,892	81,721,343	6,770,631	6,537,707